

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

根据基金管理人2012年12月4日刊登的《华夏基金管理有限公司关于修订中信现金优势货币市场基金基金合同的公告》及《关于中信现金优势货币市场基金增加基金份额类别的公告》,自2012年12月10日起,中信现金优势货币市场基金增加基金份额类别,并更名为华夏货币市场基金。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华夏货币
基金代码	288101
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年4月20日
报告期末基金份额总额	5,246,173,119.65份
投资目标	在保持安全、流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报,使货币市场和利率的预测与组合投资、采取积极的投资策略,进行货币市场工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。
业绩比较基准	本基金以中国人民银行公布的一年期定期存款税后收益率作为业绩比较基准。
风险收益特征	本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	华夏货币A
下属两级基金的基金代码	288101
报告期末下属两级基金的份额总额	2,324,972,258.39份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)	
	华夏货币A	华夏货币B
1.本期已实现收益	15,584,761.32	1,391,736.58
2.本期利润	15,584,761.32	1,391,736.58
3.期末基金资产净值	2,324,972,258.39	921,200,861.26

注:①本基金无持有未认购或赎回基金的各项费用。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

④根据《关于中信现金优势货币市场基金增加基金份额类别的公告》,本基金自2012年12月10日起增加B级基金份额类别。

3.2 净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9414%	0.0037%	0.7541%	0.0000%	0.1873%	0.0037%

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2012年12月1日至2012年12月31日	0.2419%	0.0045%	0.1721%	0.0000%	0.0698%	0.0045%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏货币市场基金 较中信现金优势货币市场基金	累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
	2005年4月20日至2012年12月31日
华夏货币A	

华夏货币市场基金 原中信现金优势货币市场基金

2012 第四季度报告

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,478,886,054.42	44.88
	其中:债券	1,478,886,054.42	44.88
2	货币资金	-	-
	其中:买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,492,102,977.87	45.28
4	其他各项资产	324,438,242.86	9.85
5	合计	3,295,427,275.15	100.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	13.41	-
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	26.79,866.51	0.83
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

报告期内本基金货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	152
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	161
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	95

报告期末投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内本基金货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	22.19	1.46
2	30天(含)-60天	6.11	-
3	60天(含)-90天	6.02	-
4	90天(含)-180天	1.86	-
5	180天(含)-397天	33.58	-
6	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计	91.52	1.46	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,967,560.52	0.62
2	央行票据	99,911,753.30	3.08
3	金融债券	328,642,653.96	10.12
4	企业债券	328,642,653.96	10.12
5	企业短期融资券	1,030,364,086.64	31.74
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,478,886,054.42	45.56
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	278,616,139.91	8.58

5.5 报告期末按摊余成本法计算的基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	004261041	12国电集CP004	1,500,000	150,111,296.32	4.62
2	110221	11国开21	1,500,000	148,136,077.91	4.56
3	004263067	12国开063	1,000,000	100,003,027.58	3.08
4	100103	10央行票据37	1,000,000	99,911,753.30	3.08
5	090407	09农发07	600,000	60,277,520.01	1.86
6	004260024	12南高速CP001	600,000	60,056,875.26	1.85
7	004252013	12美的CP001	600,000	60,046,591.48	1.85
8	110402	11农发02	500,000	50,115,287.19	1.54
9	004260074	12津管债CP001	500,000	50,097,573.21	1.54
10	004260003	12国开200	500,000	50,091,341.12	1.54

5.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

2012 第四季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	恒生恒生ETF联接
基金代码	159920
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
报告期末基金份额总额	439,559,219.02份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	恒生综合指数收益率(扣除分红再投资)
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-454,302.97
2.本期利润	14,466,996.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107
4.期末基金资产净值	454,371,479.10
5.期末基金份额总额	439,559,219.02

注:①本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

②本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

③本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.6 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.9 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.10 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.12 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.13 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.15 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.16 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.17 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.18 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.19 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.20 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

2012 第四季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。本基金投资于货币市场工具,属于低风险品种。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	恒生恒生ETF联接
基金代码	159920
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
报告期末基金份额总额	439,559,219.02份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	恒生综合指数收益率(扣除分红再投资)
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

3.1 主要财务指标

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.69%	0.21%	7.40%	-	-4.71%	-0.58%

3.2 基金净值表现

3.2.1 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.4 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.5 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.6 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.7 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.8 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.9 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.10 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.11 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.12 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.13 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.14 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.15 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.16 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.17 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.18 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.19 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.20 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.21 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.22 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.23 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.15%
报告期内偏离度的最低值	0.09%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.12%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.9 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或固定利率每日计提利息收入,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余成本计算基金资产净值。

5.8.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.8.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.10 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.12 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.13 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.15 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.17 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.18 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.19 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.20 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.22 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.23 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.24 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.25 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.26 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.27 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.28 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.29 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.30 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.31 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.32 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.33 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.34 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.35 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.36 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.37 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.38 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.39 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.40 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.41 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.42 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.43 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.44 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.45 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.46 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.47 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.48 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.49 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.50 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.51 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.52 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.53 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.54 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.55 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.56 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.57 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.58 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.59 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.60 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.61 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.62 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.63 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.64 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.65 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.66 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.67 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.68 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.69 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.70 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.71 投资组合报告附注的其他文字描述